

BỘ TÀI CHÍNH
ỦY BAN CHỨNG KHOÁN NHÀ NƯỚC

CỘNG HÒA XÃ HỘI CHỦ NGHĨA VIỆT NAM
Độc lập - Tự do - Hạnh phúc

Số: 6820/UBCK-PTTT
V/v chấp thuận mẫu Hợp đồng tương lai
trái phiếu Chính phủ 10 năm

Hà Nội, ngày 16 tháng 11 năm 2020 ĐẾN

Ngày: 17-11-2020

Số: 1221

Kính gửi:

- Sở Giao dịch Chứng khoán Hà Nội;
- Trung tâm Lưu ký Chứng khoán Việt Nam.

- Căn cứ quy định tại Khoản 1 Điều 10 Nghị định số 42/2015/NĐ-CP ngày 05/5/2015 của Chính phủ về chứng khoán phái sinh và thị trường chứng khoán phái sinh; căn cứ quy định tại Khoản 1 Điều 5 Thông tư số 11/2016/TT-BTC ngày 19/01/2016 của Bộ trưởng Bộ Tài chính hướng dẫn Nghị định số 42/2015/NĐ-CP;

- Xét đề nghị của Sở Giao dịch Chứng khoán Hà Nội tại Công văn số 1443/SGDHN-TTCKPS ngày 03/9/2020 về việc phê duyệt dự thảo mẫu Hợp đồng tương lai trái phiếu Chính phủ kỳ hạn 10 năm.

Ủy ban Chứng khoán Nhà nước thông báo:

1. Chấp thuận mẫu Hợp đồng tương lai trái phiếu Chính phủ kỳ hạn 10 năm do Sở Giao dịch Chứng khoán Hà Nội thiết kế (đính kèm).

2. Sở Giao dịch Chứng khoán Hà Nội, Trung tâm Lưu ký Chứng khoán Việt Nam phối hợp hoàn thiện các quy chế, quy định liên quan, báo cáo Ủy ban Chứng khoán Nhà nước về công tác chuẩn bị đưa sản phẩm Hợp đồng tương lai trái phiếu Chính phủ kỳ hạn 10 năm vào giao dịch để tổng hợp, báo cáo Bộ cho phép triển khai trong thời gian sớm nhất.

Ủy ban Chứng khoán Nhà nước thông báo để Sở Giao dịch Chứng khoán Hà Nội, Trung tâm Lưu ký Chứng khoán Việt Nam biết và triển khai thực hiện./.

Nơi nhận:

- Như trên;
- Lưu: VT, PTTT (04b) *ky*

CHỦ TỊCH



Trần Văn Dũng



PHỤ LỤC

Mẫu Hợp đồng tương lai trái phiếu Chính phủ kỳ hạn 10 năm

(Ban hành kèm theo Công văn số 6820/UBCK-PTTT ngày 16/11/2020 của UBCKNN)

TT	Điều khoản	Mô tả
1.	Tên hợp đồng	Hợp đồng tương lai trái phiếu Chính phủ kỳ hạn 10 năm
2.	Mã hợp đồng	Theo quy định của Sở Giao dịch Chứng khoán Hà Nội
3.	Tài sản cơ sở	Trái phiếu Chính phủ kỳ hạn 10 năm, mệnh giá 100.000 đồng, lãi suất danh nghĩa 5,0%/năm, trả lãi định kỳ cuối kỳ 12 tháng/lần, trả gốc một lần khi đáo hạn
4.	Quy mô hợp đồng	1 tỷ đồng
5.	Hệ số nhân hợp đồng	10.000
6.	Tháng đáo hạn	03 tháng cuối 3 Quý gần nhất
7.	Phương thức giao dịch	Phương thức khớp lệnh Phương thức thỏa thuận
8.	Thời gian giao dịch	<ul style="list-style-type: none">Mở cửa: sớm hơn thị trường cơ sở 15 phútĐóng cửa: cùng giờ thị trường cơ sở.
9.	Biên độ dao động	+/-3% so với giá tham chiếu
10.	Bước giá/ đơn vị yết giá	1 đồng
11.	Đơn vị giao dịch	1 hợp đồng
12.	Ngày giao dịch cuối cùng	Ngày 25 của tháng đáo hạn hoặc ngày giao dịch liền trước nếu ngày 25 là ngày nghỉ
13.	Ngày thanh toán cuối cùng	Ngày làm việc thứ ba kể từ ngày giao dịch cuối cùng
14.	Phương thức thanh toán	Chuyển giao vật chất
15.	Phương pháp xác định giá thanh toán cuối ngày	Theo quy định của Trung tâm Lưu ký Chứng khoán Việt Nam
16.	Phương pháp xác định giá thanh toán cuối cùng	Giá thanh toán cuối ngày tại ngày giao dịch cuối cùng
17.	Giá tham chiếu	Giá thanh toán cuối ngày của ngày giao dịch liền trước hoặc giá lý thuyết (trong ngày giao dịch đầu tiên)
18.	Tiêu chuẩn trái phiếu giao hàng	Trái phiếu Chính phủ do Kho bạc Nhà nước phát hành trả lãi định kỳ cuối kỳ 12 tháng/lần, và có các kỳ trả lãi bằng nhau, trả gốc một lần khi đáo hạn, có kỳ hạn còn lại từ 8 năm đến 11 năm tính đến ngày thanh toán cuối cùng, có giá trị niêm yết tối thiểu 2.000 tỷ đồng. Hệ số chuyển đổi được tính theo lãi suất danh nghĩa 5,0%/năm.
19.	Mức ký quỹ	Theo quy định của Trung tâm Lưu ký Chứng khoán Việt Nam
20.	Giới hạn lệnh	500 hợp đồng/lệnh
21.	Giới hạn vị thế	Theo quy định của Trung tâm Lưu ký Chứng khoán Việt Nam
22.	Ngày niêm yết	Khi ra mắt hợp đồng

B